

**<<資金需給>>**

単位 億円

	2日需給速報		3日需給予想	4日当社予想
	即日	金額	金額	金額
銀行券		1,200	1,000	0
財政		▲ 31,300	▲ 6,600	4,000
資金過不足		▲ 30,100	▲ 5,600	4,000
貸出				
売出手形				
0				
本店共通				
0				
全店共通				
0				
共通(固定)		5,600		
68,307		▲ 11,800		
国債買現				
0				
CP買現				
0				
国庫短期証買入		4,000		
国庫短期証売却				
国債買入		11,600	4,800	
CP等買入				
		▲ 100	▲ 100	
貸出支援基金 (成長) 46,898 (増加) 223,470				
被災地支援				
3,244				
社債等買入		▲ 100		
ETF買入			100	
国債補完供給				
小計		9,200	4,800	0
当増減		▲ 20,900	▲ 800	4,000

当座預金残高	2,091,000	6/2以降の残り所要積立額	
準備預金残高	1,915,600		10,700
積み終了先	1,608,800	6/3以降の残り所要積立額	
超過準備	1,608,800	積数	9,600
非準備先残高	175,400	1日平均	700
積み期間(5/16~6/15)の所要準備額(積数)	2,012,300		
準備預金進捗率	99.52% (実績)	58.06% (日数)	

6/1のマナリーベース				3,054,600
6/1コール	合計	195,628	無担	66,265
コール前日増減	計	▲ 240	無担	▲ 416
			有担	129,363
			有担	176

6/2の加重平均レート(速報)				6/1の加重平均レート(確報)				単位(%)
無担(平均)		有担(平均)		CP気配a-1	短国	無担当日分		有担当日分
0.060 ~0.125 (0.075)		0.030 ~0.040 (0.031)				0.055 ~0.125 (0.073)		0.030 ~0.040 (0.031)
0.066 ~0.130 (0.083)							0.065 ~0.122 (0.084)	
0.125 (0.125)								
0.118 ~0.200 (0.159)								
0.118 ~0.340 (0.149)							0.118 (0.118)	
0.118 (0.118)							0.118 (0.118)	
		0.08-0.13	-					有担先日付分
		0.08-0.12	-					
		0.08-0.12	▲0.005					
		-	-					
		-	-					

6/3の日銀調節とレート予想					
日銀調節	見送り	当座預金残高	2,090,200	前日比	▲ 800
O/N	0.06~0.075	T/N	0.055~0.12	S/N	0.055~0.12

無担O/Nは0.07%近辺での出合いが中心になると予想される。

<< 2日のインターバンク市場動向 >>  
 午前8時発表の準備預金残高見込みは、160兆9,000億円(当座預金残高見込みは209兆2,000億円)。朝方の無担O/Nは、地銀、信託から0.07~0.072%、大手行からは0.065~0.069%での調達希望で始まり、出合いの中心は0.072~0.073%と昨日とほぼ同水準の立ち上がりとなった。一巡後も0.07%近辺での出合いが散見されつつ、本日の取引を終えた。また、一部業態が試し取りを行ったため、加重平均が若干上昇した。ターム物に関しては、目立った出合いは見られなかった。

<< 2日のオープン市場動向 >>  
 現先S/Nは、横ばい圏での推移となった。短国市場は3Mで▲0.005%の出合いが見られたが、引き続き全体的に動意に乏しいマーケットとなった。CP発行市場は、700億円程度の償還に対して、発行は350億円程度と小規模にとどまった。発行レートは期内償還物を中心に小幅上昇する場面が見られた。

- << 3日の材料 >>
- \*白井日銀審議委員、三重県金融経済懇談会にて講演
  - \*ECB定例理事会(金融政策発表)
  - \*MPC(英中銀金融政策委員会、1日目)
  - \*米国ページブック
  - \*米国4月の貿易収支 \*米国5月のISM非製造業景況指数
  - \*交付税特別会計借入(10,500億円、6/11借入)

6/3のコール5月の加重平均レート			
(土日を含む)	無担	0.06945%	有担 0.03100%
(営業日のみ)	無担	0.06928%	有担 0.03100%

JGB新発10年債	0.410	0.010	日経平均株価(終値)	20,543.19	▲ 26.68	為替(9時)	124.85-88
						為替(5時)	124.62-64

O/N加重平均レートと日銀当座預金残高及び準備預金残高の推移						
日付	5/26	5/27	5/28	5/29	6/1	6/2
日銀当座預金	2,102,800	2,135,700	2,119,800	2,130,200	2,111,900	2,091,000
準備預金残	1,913,100	1,942,400	1,927,500	1,944,600	1,931,900	1,915,600
レート	0.071%	0.074%	0.071%	0.073%	0.073%	0.075%
月中平均	0.06881%	0.06900%	0.06907%	0.06945%	0.07300%	0.07400%

**<<オペ情報、入札結果>>**

米ドル資金供給(固定金利方式) 6/4~6/11(7日間) 応札なし 貸付利率 0.630%  
 10年利付国債(表面利率0.4%) 応札5兆9,073億円 落札2兆1,819億円(I非競争入札:2,104億円) 6/22~2025/6/20 0.453% 按分39.9052% 平均0.450%  
 預保借入(金融再生勘定) 1,000億円 6/12~2016/6/10 応札 5,085億円 落札 1,000億円 0.083% 按分39.000% 平均0.079%

「このレポートは、参考資料としてのみ作成しております。売買に関する最終判断はお客様ご自身でなされますようお願い申し上げます。」

金融商品のお取引には価格変動等によるリスクがあります。金融商品のお取引には手数料等をご負担頂くものがあります。金融商品取引法に基づきお渡しする書面や目論見書をよくお読みください。セントラル短資株式会社 登録金融機関 関東財務局長(登金)第526号 日本証券業協会加入